

(上接B182版)					
		注册地址:北京市西城区金融街19号富都大厦B座701 办公地址:北京市西城区南礼士路外大街28号C座5层 法定代表人:林义和 联系人:董颖 客服电话:010-66064678 传真:010-66064618 网址:https://www.baiyuan.com.cn 公司基金网站:https://pjb.baiyuan.com.cn/		注册地址:深圳市福田区福新街同创汇7号A座3801室 办公地址:深圳市福田区益田路大中华大厦28层 联系人:王凌 电话:010-83963101 传真:010-83330372 客服电话:400-166-1188 网址:https://bj.yjy.com.cn	
61	天相投资管理有限公司	注册地址:广东省深圳市福田区江北东江三路惠州广厦科技园二期C-202楼 办公地址:广东省深圳市福田区江北东江三路惠州广厦科技园二期C-202楼 法定代表人:徐刚 联系人:李海 电话:0755-2111899 传真:0755-2111899 客服电话:0755-2111899 网址:www.txcm.com.cn		注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦8层12、13层 办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦8层12、13层 法定代表人:魏庆华 联系人:魏庆华 电话:010-65667910-65667971 传真:010-65661333 客服电话:010-65661333 网址:www.dzqjw.cn	
62	联讯证券股份有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门27层B座 办公地址:西安市高新区锦业路1号都市之门27层B座 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com	
63	东吴证券股份有限公司	注册地址:江苏省南京市秦淮区太平门街11号 办公地址:江苏省南京市秦淮区太平门街11号 法定代表人:范力 联系人:范力 电话:025-82292299 传真:025-82292299 客服电话:025-82292299 网址:www.rdw.com.cn		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
64	开源证券股份有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
65	中邮证券有限责任公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
66	太平洋证券股份有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
67	安信证券股份有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
68	网信证券股份有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
69	天风证券股份有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
70	联讯证券股份有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
71	川财证券有限责任公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
72	中信建投证券股份有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
73	中邮证券有限责任公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
74	阳光人寿保险股份有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
75	弘业期货股份有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
76	方正证券股份有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
77	深圳弘业期货股份有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
78	上海好买基金销售有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
79	新凯(杭州)基金销售有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
80	上海星展基金销售有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
81	上海天天基金销售有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
82	北京国信证券有限责任公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
83	浙江同花顺基金销售有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
84	北京中邮时代基金销售有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
85	锦泰基金销售有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
86	和讯信息科技有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
87	安信证券股份有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
88	浙江金观诚基金销售有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
89	诺亚财富基金销售有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	
90	嘉实财富管理有限公司	注册地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 办公地址:陕西省西安市雁塔区雁塔南路17号18层 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:029-88266035 客服电话:029-88266035 网址:www.lxsec.com		注册地址:北京市东城区东直门内大街19号 办公地址:北京市东城区东直门内大街19号 法定代表人:李刚 联系人:李刚 电话:010-67698721 传真:010-67698721 客服电话:010-67698721 网址:www.dzqjw.cn	

状况,寻找增长空间较大、持续性较强的行业,寻找经济转型中受益程度最高的行业,结合动态分析行业发展周期、与上下游关系与谈判地位,寻找产业链中由弱转强或优势扩大的行业。

在个股的选择上,首先按照风险性由低至高、中期上涨幅力由高至低和流动性由高到低对股票池内的股票进行排名,累计前三项得到综合排名,取综合排名靠前的股票构建股票组合,进行组合投资。

本基金通过选择风险低的股票,保证组合的稳定性;通过选择具有中期上涨潜力的股票,保证组合的收益性;通过分散投资、组合投资和流动性管理,降低个股集中性风险和流动性风险。

4、股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值管理。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

5、权证投资策略

本基金将以被动投资策略作为主要策略,包括投资因持有股票而派发的权证和参与分离转债申购而获得的权证,以获取这部分权证带来的增值收益。同时,本基金将在充分控制风险的前提下,以价值分析为基础,主动进行部分权证投资。

6、资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,采用基本面分析和数量化模型相结合,对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

今后,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

§ 9 基金业绩比较基准

沪深300指数收益率×15%+上证国债指数收益率×85%

本基金是以债券投资为主的混合型基金,以“沪深300指数收益率×15%+上证国债指数收益率×85%”作为本基金的业绩比较基准,能够体现本基金资产判断本基金的合理风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金可以在与基金托管人协商一致的情况下,报中国证监会备案后变更业绩比较基准并发布公告,无需召开基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时,基金管理人可以按相关监管机构要求履行相关手续后,依据维护基金份额持有人合法权益的原则,选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数,而无需召开基金份额持有人大会。

§ 10 基金的风险收益特征

本基金为债券投资为主的混合型基金,属于中低风险、中收益预期的基金品种,其风险收益预期高于货币型基金和债券型基金,低于股票型基金。

§ 11 基金投资报告

基金管理人及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。基金托管人根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至2019年3月31日(未经审计)。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	16,123,397.69	17.91
2	其中:股票	16,123,397.69	17.91
3	固定收益投资	66,207,306.00	73.48
4	其中:债券	66,207,306.00	73.48
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	3,000,000.00	3.33
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行间同业拆借净支付/收款	3,187,090.67	3.54
11	其他资产	1,573,670.88	1.76
12	合计	90,101,458.24	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	176,527.00	0.22
C	制造业	7,329,473.09	9.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,096,301.00	1.38
F	批发和零售业	923,677.00	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	496,948.00	0.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	4,343,134.00	5.46
J	金融业	688,340.00	0.84
K	房地产业	693,947.00	0.87
L	租赁和商务服务业	181,032.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	医药制造业	-	-
P	医药批发业	100,580.00	0.13
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	241,024.00	0.30
S	综合	-	-
合计	合计	16,123,397.69	20.27

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未有港股通股票投资。

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601388	工商银行	300,100	1,671,557.00	2.10
2	601009	南京银行	192,900	1,446,739.00	1.82
3	000661	格力电器	17,800	940,339.00	1.06
4	600088	海澜之星	18,700	783,890.00	0.93
5	600104	上汽集团	28,100	732,567.00	0.92
6	600741	华域汽车	34,000	692,320.00	0.87
7	600297	东方金钰	689,000	689,047.00	0.87
8	601328	交通银行	109,400	682,656.00	0.86
9	600619	贵州茅台	702	590,598.00	0.76
10	000418	小天鹅A	9,400	535,142.00	0.67

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	-	国债逆回购	-	-
2	-	央行票据	-	-
3	-	金融债券	17,021,900.00	21.39
4	-	其中:政策性金融债	10,017,000.00	12.68
5	-	企业债券	29,977,500.00	37.66
6	-	企业短期融资券	-	-
7	-	中期票据	-	-
8	-	可转换债(可交换债)	22,900.00	0.03
9	-	同业存单	19,185,000.00	24.10
10	合计	合计	66,207,306.00	83.18

5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190407	19农发07	100,000	10,017,000.00	12.68
2	11189894	18杭州银行CD049	100,000	9,993,000.00	12.65
3	11182123	18海海银行CD223	100,000	9,992,000.00	12.65
4	136510	16华明10	75,000	7,494,750.00	9.42
5	136544	16联融03	75,000	7,494,750.00	9.42

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未有资产支持证券。

7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未有贵金属。

8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值管理。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资策略

无。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

10.3 本期国债期货投资评价

无。

11 投资组合报告附注

11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是,还应对其被调查或处罚的原因作出说明。

报告期内基金投资的前十名证券除18渤海银行CD223(证券代码111821223)外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

处罚日期:2018年11月9日 处罚原因:(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)理财及自营投资资金违规用于缴交土地款;(三)理财业务风险隔离不到位;(四)为非保本理财产品提供保本承诺;(五)同业投资他行非保本理财产品审查不到位。处罚结果:罚款25307元。

对上述证券的投资决策程序的说明:本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是,还应对其超出基金合同规定的备选股票库作出说明。

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。本基金管理人已制度和流程上要求股票必须事先入库再买入。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,516.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,561,945.29
5	应收申购款	209.08
6		